

**长安沪深300非周期行业指数证券投资基金2013年半年度报告**

**2013年06月30日**

**基金管理人：长安基金管理有限公司**

**基金托管人：广发银行股份有限公司**

**送出日期：2013年08月29日**

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人广发银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013年8月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年1月1日起至6月30日止。

## 1.2 目录

1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介.....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告.....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	10
§5 托管人报告.....	10
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	10
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	11
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	11
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	11
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告.....	34
7.1 期末基金资产组合情况.....	34
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	35
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细.....	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	43
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	43
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	43
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细.....	44
7.10 投资组合报告附注.....	44
§8 基金份额持有人信息.....	45
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	45
§9 开放式基金份额变动.....	45
§10 重大事件揭示.....	45
10.1 基金份额持有人大会决议.....	45
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	46

10.4	基金投资策略的改变.....	46
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	46
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况.....	46
10.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	46
10.8	其他重大事件.....	47
§11	影响投资者决策的其他重要信息.....	48
§12	备查文件目录.....	48
12.1	备查文件目录.....	48
12.2	存放地点.....	48
12.3	查阅方式.....	48

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	长安沪深300非周期行业指数证券投资基金
基金简称	长安沪深300非周期
基金主代码	740101
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年06月25日
基金管理人	长安基金管理有限公司
基金托管人	广发银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	43,929,724.90

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票型指数基金，力求通过对沪深300非周期行业指数进行完全复制，在严格控制跟踪误差的基础上，为投资者提供一个投资于沪深300非周期行业指数的有效工具。
投资策略	本基金采用完全复制方法跟踪标的指数，即按照沪深300非周期行业指数的成分股组成及权重构建股票投资组合，进行被动指数化投资。
业绩比较基准	沪深300非周期行业指数收益率*95%+活期存款利率（税后）*5%
风险收益特征	本基金为跟踪指数的股票型基金，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，属于证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	长安基金管理有限公司	广发银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张洪水
	联系电话	021-20329995
	电子邮箱	zhanghongshui@changanfunds.com
		寻卫国
		010-65169606
		xunweiguo@gdb.com.cn

客户服务电话	400-820-9688	400-830-8003
传真	021-20329888	010-65169555
注册地址	上海市虹口区丰镇路806号3幢371室	广东省广州市越秀区东风东路713号
办公地址	上海市浦东新区芳甸路1088号紫竹国际大厦16层	北京市东城区大华路2号广发银行大厦四层
邮政编码	201204	100005
法定代表人	万跃楠	董建岳

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.changanfunds.com">http://www.changanfunds.com</a>
基金半年度报告备置地点	上海市浦东新区芳甸路1088号紫竹国际大厦16层

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市南京西路1266号恒隆广场1期50楼
注册登记机构	长安基金管理有限公司	上海市浦东新区芳甸路1088号紫竹国际大厦16层

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2013年01月01日-2013年06月30日）
本期已实现收益	6,289,004.51
本期利润	996,638.03
加权平均基金份额本期利润	0.0142

本期加权平均净值利润率	1.37%
本期基金份额净值增长率	-4.45%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	报告期末（2013年06月30日）
期末可供分配利润	-1,448,555.75
期末可供分配基金份额利润	-0.0330
期末基金资产净值	42,481,169.15
期末基金份额净值	0.9670
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	报告期末（2013年06月30日）
基金份额累计净值增长率	-3.30%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-11.45%	1.54%	-11.80%	1.57%	0.35%	-0.03%
过去三个月	-5.93%	1.21%	-6.63%	1.23%	0.70%	-0.02%
过去六个月	-4.45%	1.20%	-4.47%	1.21%	0.02%	-0.01%
过去一年	-3.20%	1.04%	-7.94%	1.16%	4.74%	-0.12%
自基金合同生效日起至今（2012年06月25日-2013年06月30日）	-3.30%	1.03%	-9.65%	1.15%	6.35%	-0.12%

注：本基金整体业绩比较基准构成为：沪深300非周期行业指数收益率×95%+活期存款利率（税后）×5%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益

## 率变动的比较



注：本基金自基金合同生效之日起6个月为建仓期，建仓期结束时投资组合比例符合基金合同约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

长安基金管理有限公司成立于2011年9月5日，公司的股东分别为：长安国际信托股份有限公司、上海美特斯邦威服饰股份有限公司、上海磐石投资有限公司、兵器装备集团财务有限责任公司。

目前，除本基金外，长安基金管理有限公司另管理2只开放式证券投资基金，基本情况如下：

#### 1、长安宏观策略股票型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

成立日期：2012年3月9日

投资目标：本基金在宏观策略研判的基础上，通过强化配置景气行业及精选基本面良好、成长性突出的上市公司，在有效控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。

#### 2、长安货币市场证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

成立日期：2013年1月25日

投资目标：本基金在保持基金资产的安全性和流动性的前提下，通过主动式管理，力求获得超过基金业绩比较基准的稳定回报。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王磊	本基金的基金经理	2012年06月25日	—	6年	吉林大学经济学硕士。曾任中邮创业基金管理有限公司战略发展部副总经理、国金通用基金管理有限公司筹备期研究员等职。2011年8月加入长安基金管理有限公司，任基金经理助理，2012年6月25日至今任长安沪深300非周期行业指数基金的基金经理。

注：1、任职日期和离任日期均指公司做出决定后正式对外公告之日；

2、证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了公平对待各类投资人，保护各类投资人利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，公司根据《证券投资基金法》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部规章，拟定了《公平交易管理办法》，对公司管理的各类资产的公平对待做了明确具体的规定，并规定对买卖股票、债券时候的价格和市场价格差距较大，可能存在操纵股价、利益输送等违法违规情况进行监控。本报告期，按照时间优先、价格优先的原则，本公司对满足限价条件且对同一证券有相同交易需求的基金等投资组合，均采用了系统中的公平交易模块进行操作，实现了公平交易；未出现清算不到位的情况，且本基

金及本基金与本基金管理人管理的其他投资组合之间未发生法律法规禁止的反向交易及交叉交易。

#### **4.3.2 异常交易行为的专项说明**

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的5%。

#### **4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明**

##### **4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析**

截止本报告期末，本基金本基金将坚持既定的指数化投资策略，在指数权重调整和基金申赎变动时，应用指数复制和数量化技术减低冲击成本和减少跟踪误差。

##### **4.4.2 报告期内基金的业绩表现**

截至2013年6月30日，本基金份额净值为0.967元。报告期内，本基金份额净值增长率为-4.45%，同期业绩基准增长率为-4.47%。

#### **4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望**

本基金为被动式指数型基金，基金管理人将按照基金合同的要求，坚持指数化投资策略，通过运用定量分析的手段，分析和应对导致基金跟踪误差的因素，继续努力将基金的跟踪误差控制在较低水平。

#### **4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明**

本基金管理人制订了健全、有效的估值政策和程序，清算登记部按照管理层批准后的估值政策进行估值。对于在交易所上市的证券，采用交易所发布的行情信息来估值。对于固定收益品种，采用证券投资基金估值工作小组免费提供的固定收益品种的估值处理标准。除了投资总监外，其他基金经理不参与估值政策的决策。但是对于非活跃投资品种，基金经理可以提供估值建议。上述参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本基金本报告期内未进行利润分配。

## **§ 5 托管人报告**

### **5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明**

本报告期内，广发银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对长安沪深300非周期行业指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，完全尽职尽责地履行了应尽的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

## 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作方面进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

## 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：长安沪深300非周期行业指数证券投资基金

报告截止日：2013年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2013年06月30日	上年度末 2012年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.6.1	3,458,396.19	9,468,820.51
结算备付金		—	187,479.52
存出保证金		100,126.95	750,000.00
交易性金融资产	6.4.6.2	39,730,919.73	121,808,580.08
其中：股票投资		39,730,919.73	121,808,580.08
基金投资		—	—
债券投资		—	—
资产支持证券投资		—	—
衍生金融资产	6.4.6.3	—	—

买入返售金融资产	6.4.6.4	—	—
应收证券清算款		—	—
应收利息	6.4.6.5	781.56	1,723.94
应收股利		27,738.12	—
应收申购款		—	689.65
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.6.6	—	—
资产总计		43,317,962.55	132,217,293.70
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2013年06月30日</b>	<b>上年度末 2012年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		—	—
交易性金融负债		—	—
衍生金融负债	6.4.6.3	—	—
卖出回购金融资产款		—	—
应付证券清算款		—	—
应付赎回款		957.59	1,262,112.32
应付管理人报酬		38,419.98	106,118.74
应付托管费		5,762.98	15,917.80
应付销售服务费		—	—
应付交易费用	6.4.6.7	21,330.57	52,646.11
应交税费		—	—
应付利息		—	—
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	6.4.6.8	770,322.28	1,219,756.68
负债合计		836,793.40	2,656,551.65
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.6.9	43,929,724.90	128,002,700.63
未分配利润	6.4.6.10	-1,448,555.75	1,558,041.42
所有者权益合计		42,481,169.15	129,560,742.05

负债和所有者权益总计		43,317,962.55	132,217,293.70
------------	--	---------------	----------------

注：1、报告截止日2013年6月30日，基金份额净值0.967元，基金份额总额43,929,724.90份。

2、本基金合同于2012年6月25日生效，本财务报表的实际编制期间为2013年1月1日至2013年6月30日。

## 6.2 利润表

会计主体：长安沪深300非周期行业指数证券投资基金

本报告期：2013年01月01日-2013年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2013年01月01日-2013年06月30日	上年度可比期间2012年06月25日-2012年06月30日
一、收入		1,947,686.42	-99,945.36
1.利息收入		23,019.12	30,256.48
其中：存款利息收入	6.4.6.11	23,019.12	30,256.48
债券利息收入		—	—
资产支持证券利息收入		—	—
买入返售金融资产收入		—	—
其他利息收入		—	—
2.投资收益（损失以“-”填列）		7,103,935.31	7,727.14
其中：股票投资收益	6.4.6.12	6,671,880.12	670.14
基金投资收益		—	—
债券投资收益	6.4.6.13	—	—
资产支持证券投资收益		—	—
衍生工具收益	6.4.6.14	—	—
股利收益	6.4.6.15	432,055.19	7,057.00
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.6.16	-5,292,366.48	-137,928.98

4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		—	—
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.6.17	113,098.47	—
<b>减：二、费用</b>		951,048.39	114,089.25
1. 管理人报酬		365,661.47	37,830.67
2. 托管费		54,849.19	5,674.59
3. 销售服务费		—	—
4. 交易费用	6.4.6.18	210,217.61	56,722.11
5. 利息支出		—	—
其中：卖出回购金融资产支出		—	—
6. 其他费用	6.4.6.19	320,320.12	13,861.88
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		996,638.03	-214,034.61
减：所得税费用		—	—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		996,638.03	-214,034.61

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长安沪深300非周期行业指数证券投资基金

本报告期：2013年01月01日-2013年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2013年01月01日-2013年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	128,002,700.63	1,558,041.42	129,560,742.05
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	996,638.03	996,638.03
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-84,072,975.73	-4,003,235.20	-88,076,210.93

其中：1.基金申购款	2,425,479.13	136,723.00	2,562,202.13
2.基金赎回款（以“-”号填列）	-86,498,454.86	-4,139,958.20	-90,638,413.06
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	—	—	—
五、期末所有者权益（基金净值）	43,929,724.90	-1,448,555.75	42,481,169.15
项 目	上年度可比期间 2012年06月25日-2012年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	277,132,832.76	—	277,132,832.76
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	-214,034.61	-214,034.61
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	—	—	—
其中：1.基金申购款	—	—	—
2.基金赎回款（以“-”号填列）	—	—	—
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	—	—	—
五、期末所有者权益（基金净值）	277,132,832.76	-214,034.61	276,918,798.15

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1

至6.4财务报表由下列负责人签署：

黄陈

李卫

王峰

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

主管会计工作负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

长安沪深300非周期行业指数基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")《关于核准长安沪深300非周期行业指数基金募集的批复》(证监许可[2012]130号文)批准,由长安基金管理有限公司(以下称"长安基金公司")依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《长安沪深300非周期行业指数基金基金合同》于2012年5月14日至2012年6月20日公开发售,募集资金总额人民币277,132,832.76元,其中扣除认购费后的有效认购资金人民币277,072,819.54元,有效认购资金在募集期间产生利息人民币60,013.22元,共折合277,132,832.76份基金份额。上述募集资金已经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了KPMG-B(2012)CRNo.0049号验资报告。基金为契约型开放式基金,存续期限不定,基金合同于2012年6月25日生效。本基金的基金管理人为长安基金公司,基金托管人为广发银行股份有限公司(以下称"广发银行")。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《长安沪深300非周期行业指数基金基金合同》和《长安沪深300非周期行业指数基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括沪深300非周期行业指数的成分股及其备选成分股(包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票)、新股(一级市场初次发行和增发)、债券、回购、货币市场工具、银行存款、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资组合的比例范围为:沪深300非周期行业指数成分股及其备选成分股的投资比例不低于基金资产的90%,在任何交易日日终持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和不超过基金资产净值的100%,每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,权证占基金资产净值的比例为0-3%,其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

本基金的股票投资部分的业绩比较基准为沪深300非周期行业指数,现金或者到期日在一年以内的政府债券投资部分为活期存款利率(税后),复合业绩比较基准为:沪深300非周期行业指数收益率 $\times$ 95%+活期存款利率(税后) $\times$ 5%。

根据《证券投资基金信息披露管理办法》,本基金定期报告在公开披露的第二个工作日,报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照中华人民共和国财政部(以下简称"财政部")于2006年2月15日颁布的《企业会计准则-基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")的要求编制,同时亦按照中国证监会公告[2010]5号《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报

告和半年度报告》以及中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制。

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本基金2013年半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2013年6月30日的财务状况以及2013年1月1日至2013年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

##### **6.4.3.1 会计年度**

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本财务报表的实际编制期间为2013年1月1日至2013年6月30日。

##### **6.4.3.2 记账本位币**

人民币

##### **6.4.3.3 金融资产和金融负债的分类**

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的把金融资产和金融负债分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债(包括交易性金融资产或金融负债)：本基金持有为了近期内出售或回购的金融资产和金融负债属于此类。衍生工具所产生的金融资产和金融负债在资产负债表中以衍生金融资产和衍生金融负债列示。应收款项：应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。持有至到期投资：本基金将有明确意图和能力持有至到期的且到期日固定、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产分类为持有至到期投资。可供出售金融资产：本基金将在初始确认时即被指定为可供出售的非衍生金融资产以及没有归类到其他类别的金融资产分类为可供出售金融资产。其他金融负债：其他金融负债是指除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债。

##### **6.4.3.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认**

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于支付价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或

上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

初始确认后，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益；应收款项和其他金融负债以实际利率法按摊余成本计量。

当收取某项金融资产的现金流量的合同权利终止或将所有权上几乎所有的风险和报酬转移时，本基金终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

#### **6.4.3.5 金融资产和金融负债的估值原则**

存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### **6.4.3.6 金融资产和金融负债的抵销**

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的；本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### **6.4.3.7 实收基金**

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份

额数及确定的拆分比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.3.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于年末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

#### 6.4.3.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资收益/(损失)、债券投资收益/(损失)和衍生工具收益/(损失)按相关金融资产于处置日以成交金额与其成本的差额确认。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税(适用于企业债和可转债等)后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息收入。

存款利息收入按存款本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在回购期内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益/(损失)核算基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、衍生金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

#### 6.4.3.10 费用的确认和计量

根据《长安沪深300非周期行业指数基金基金合同》的规定，基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.00%的年费率逐日计提。

根据《长安沪深300非周期行业指数基金基金合同》的规定，基金托管费按前一日基金资产净值0.15%的年费率逐日计提。

本基金的交易费用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在回购期内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如不影响估值日基金份额净值小数点后第三位，发生时直接计入基金损益；如果影响基金份额净值小数点后第三位的，应采用待摊或预提的方法，待摊或预提计入基金损益。

#### 6.4.3.11 基金的收益分配政策

根据《长安沪深300非周期行业指数基金基金合同》的规定，本基金同份额类别每份基金份额享有同等分配权。在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为12次，每份基金份额每次分配比例不得低于该次可供分配利润的20%；若基金合同生效不满3个月，可不进行收益分配。基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，基金投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。

#### 6.4.3.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于特殊事项停牌股票，根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，本基金参考《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票进行估值。

对于在锁定期内的非公开发行股票，中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》(以下简称"《证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价的通知》")，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易所交易天数占锁定期内总交易所交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

在银行间同业市场交易的债券品种，根据《证券投资基金执行<企业会计准则>估值

业务及份额净值计价的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

#### 6.4.4 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.4.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 6.4.4.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 6.4.4.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.5 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(2)基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴20%的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，暂按25%计入应纳税所得额，适用20%的税率计征个人所得税，实际税负为5%，由上市公司在向基金派发股息、红利时代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。基金在股权登记日后转让股票时，中登上海分公司根据其持股期限计算实际应纳税额，超过已扣缴税款的部分，由证券公司等股份托管机构从个人资金账户中扣收并划付中登上海分公司。具体实际税负为：股东的持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额，实际税负为20%；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额，实际税负为10%；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额，实际税负为5%。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

## 6.4.6 重要财务报表项目的说明

### 6.4.6.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2013年06月30日
活期存款	3,458,396.19
合计	3,458,396.19

### 6.4.6.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2013年06月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		40,412,241.94	39,730,919.73	-681,322.21
债券	交易所市场	—	—	—
	银行间市场	—	—	—
	合计	—	—	—
资产支持证券		—	—	—
其他		—	—	—
合计		40,412,241.94	39,730,919.73	-681,322.21

### 6.4.6.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

### 6.4.6.4 买入返售金融资产

#### 6.4.6.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.6.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未通过买断式逆回购交易取得债券。

### 6.4.6.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2013年06月30日
----	--------------------

应收活期存款利息	736.46
应收其他存款利息	45.10
应收结算备付金利息	—
应收债券利息	—
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	—
其他	—
合计	781.56

#### 6.4.6.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.6.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2013年06月30日
交易所市场应付交易费用	21,330.57
银行间市场应付交易费用	—
合计	21,330.57

#### 6.4.6.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2013年06月30日
应付券商交易单元保证金	500,000.00
应付赎回费	2.16
应付指数使用费	2,876.86
预提审计费用	39,671.58
指数化信息披露费	227,771.68
合计	770,322.28

#### 6.4.6.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2013年01月01日-2013年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	128,002,700.63	128,002,700.63
本期申购	2,425,479.13	2,425,479.13
本期赎回（以“-”号填列）	-86,498,454.86	-86,498,454.86
本期末	43,929,724.90	43,929,724.90

注：1、申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

2、本基金自2012年5月14日至2012年6月20日止期间公开发售，共募集有效净认购资金277,072,819.54元，折合277,072,819.54份基金份额；在募集期间认购资金产生的利息为人民币60,013.22元，折合60,013.22元份基金份额；以上实收基金（本息）合计为人民币277,132,832.76元，折合277,132,832.76份基金份额。

#### 6.4.6.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-4,687,939.25	6,245,980.67	1,558,041.42
本期利润	6,289,004.51	-5,292,366.48	996,638.03
本期基金份额交易产生的变动数	600,388.25	-4,603,623.45	-4,003,235.20
其中：基金申购款	1,291.06	135,431.94	136,723.00
基金赎回款（以“-”号填列）	599,097.19	-4,739,055.39	-4,139,958.20
本期已分配利润	—	—	—
本期末	2,201,453.51	-3,650,009.26	-1,448,555.75

#### 6.4.6.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2013年01月01日-2013年06月30日
活期存款利息收入	21,226.98
结算备付金利息收入	248.78
其他	1,543.36
合计	23,019.12

注：其他指交易保证金和结算保证金利息收入。

### 6.4.6.12 股票投资收益

#### 6.4.6.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2013年01月01日-2013年06月30日
卖出股票成交总额	96,953,648.73
减：卖出股票成本总额	90,281,768.61
买卖股票差价收入	6,671,880.12

### 6.4.6.13 债券投资收益

本基金本报告期内未获得债券投资收益。

### 6.4.6.14 衍生工具收益

#### 6.4.6.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内未获得衍生工具收益。

### 6.4.6.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2013年01月01日-2013年06月30日
股票投资产生的股利收益	432,055.19
基金投资产生的股利收益	—
合计	432,055.19

### 6.4.6.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2013年01月01日-2013年06月30日
1.交易性金融资产	-5,292,366.48
——股票投资	-5,292,366.48
——债券投资	—

——资产支持证券投资	—
2.衍生工具	—
——权证投资	—
3.其他	—
合计	-5,292,366.48

#### 6.4.6.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2013年01月01日-2013年06月30日
基金赎回费收入	113,098.47
合计	113,098.47

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的25%归入基金资产。

#### 6.4.6.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2013年01月01日-2013年06月30日
交易所市场交易费用	210,217.61
银行间市场交易费用	—
合计	210,217.61

#### 6.4.6.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2013年01月01日-2013年06月30日
审计费用	39,671.58
信息披露费	227,771.68
银行手续费	—
指数使用费	52,876.86
银行间帐户维护费	—

其他费用	—
合计	320,320.12

#### 6.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.7.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

##### 6.4.7.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.8 关联方关系

##### 6.4.8.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

##### 6.4.8.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
长安基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
广发银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构

#### 6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.9.1.1 股票交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 6.4.9.1.2 权证交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 6.4.9.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内无应支付给关联方的佣金。

##### 6.4.9.2 关联方报酬

###### 6.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2013年01月01日-2013年 06月30日	上年度可比期间 2012年06月25日-2012年06月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	365,661.47	37,830.67
其中：支付销售机构的客户维护费	108,143.64	8,041.85

注：1、支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.0%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×1.0%/当年天数。

2、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

#### 6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2013年01月01日-2013年 06月30日	上年度可比期间 2012年06月25日-2012年06月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	54,849.19	5,674.59

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

#### 6.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.9.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.9.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期内无基金管理人之外的其他关联方投资本基金。

#### 6.4.9.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年01月01日-2013年06月30 日		上年度可比期间 2012年06月25日-2012年06月30 日	
	期末 余额	当期 存款利息收入	期末 余额	当期 存款利息收入
广发银行股份 有限公司	3,458,396.19	21,226.98	222,385,510.76	30,256.48

注：本基金的银行存款由基金托管人广发银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.9.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内购入关联方承销证券。

#### 6.4.9.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

#### 6.4.10 利润分配情况

##### 6.4.10.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金本报告期内未实施利润分配。

#### 6.4.11 期末（2013年06月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.11.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末未因认购新股/新债而持有流通受限证券。

##### 6.4.11.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值单价	复牌 日期	复牌 开盘单价	数量	期末 成本总额	期末 估值总额
600598	北大荒	2013-05-24	重大事项	8.35	2013-07-19	7.52	16,572	139,075.59	138,376.20
601989	中国重工	2013-05-16	重大事项	4.52		—	117,582	569,899.08	531,470.64
000999	华润三九	2013-05-31	资产重组	29.60	2013-08-19	26.41	9,333	212,766.16	276,256.80

注：本基金持有的暂时停牌股票中国重工截止本报告公告时尚未复牌。

##### 6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

### 6.4.11.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

### 6.4.11.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

## 6.4.12 金融工具风险及管理

### 6.4.12.1 风险管理政策和组织架构

本基金为被动型股票型指数基金，力求通过对沪深300非周期行业指数进行完全复制，在严格控制跟踪误差的基础上，为投资者提供一个投资于沪深300非周期行业指数的有效工具。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括沪深300非周期行业指数的成分股及其备选成分股（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、新股（一级市场初次发行和增发）、债券、回购、货币市场工具、银行存款、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人按照“健全、合理、制衡、独立”的原则，建立了合规与风险管理委员会（董事会层面）、督察长、监察稽核部和相关部门构成的全方位、多层级的合规风险管理架构。本基金管理人秉承全面风险管理的理念，将风险管理贯穿日常经营活动的整个过程，渗透到各个业务环节，覆盖所有部门和岗位，建立了集风险识别、风险测量、风险控制、风险评价、风险报告为一体的风险管理机制，全面、及时识别、分析和评估各类风险，有效防范日常经营和基金运作过程中可能面临的各种风险，最大限度地保护基金份额持有人的合法权益。

### 6.4.12.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行广发银行，因而与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，因此违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

### 6.4.12.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来

自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的10%。

本基金所持有的金融负债的合约约定剩余到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### **6.4.12.4 市场风险**

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### **6.4.12.4.1 利率风险**

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等，其余大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

本基金于2013年6月末未持有债券投资，无重大利率风险，因而未进行敏感性分析。银行存款及结算备付金之浮动利率根据中国人民银行的基准利率和相关机构的相关政策浮动。

##### **6.4.12.4.1.1 利率风险敞口**

金额单位：人民币元

本期末2013年 06月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,458,396.19	—	—	—	3,458,396.19
存出保证金	100,126.95	—	—	—	100,126.95
交易性金融资产	—	—	—	39,730,919.73	39,730,919.73
应收利息	—	—	—	781.56	781.56
应收股利	—	—	—	27,738.12	27,738.12
资产总计	3,558,523.14	—	—	39,759,439.41	43,317,962.55
负债					
应付赎回款	—	—	—	957.59	957.59
应付管理人报酬	—	—	—	38,419.98	38,419.98
应付托管费	—	—	—	5,762.98	5,762.98
应付交易费用	—	—	—	21,330.57	21,330.57
其他负债	—	—	—	770,322.28	770,322.28
负债总计	—	—	—	836,793.40	836,793.40
利率敏感度缺口	3,558,523.14	—	—	38,922,646.01	42,481,169.15
上年度末2012 年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	9,468,820.51	—	—	—	9,468,820.51
结算备付金	187,479.52	—	—	—	187,479.52
存出保证金	750,000.00	—	—	—	750,000.00
交易性金融资产	—	—	—	121,808,580.08	121,808,580.08

应收利息	—	—	—	1,723.94	1,723.94
应收申购款	—	—	—	689.65	689.65
资产总计	10,406,300.03	—	—	121,810,993.67	132,217,293.70
负债					
应付赎回款	—	—	—	1,262,112.32	1,262,112.32
应付管理人报酬	—	—	—	106,118.74	106,118.74
应付托管费	—	—	—	15,917.80	15,917.80
应付交易费用	—	—	—	52,646.11	52,646.11
其他负债	—	—	—	1,219,756.68	1,219,756.68
负债总计	—	—	—	2,656,551.65	2,656,551.65
利率敏感度缺口	10,406,300.03	—	—	119,154,442.02	129,560,742.05

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.12.4.1.2 利率风险的敏感性分析

截至本报告期末，本基金未持有受重大利率风险影响的投资品种。

#### 6.4.12.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.12.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，所面临的其他价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

##### 6.4.12.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末		上年度末	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	39,730,919.73	93.53	121,808,580.08	94.02
交易性金融资产-债券投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	39,730,919.73	93.53	121,808,580.08	94.02

#### 6.4.12.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深300非周期指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末	上年度末
	沪深300非周期指数下降5%	-1,957,275.65	-6,151,621.11
	沪深300非周期指数上升5%	1,957,275.65	6,151,621.11

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	39,730,919.73	91.72
	其中：股票	39,730,919.73	91.72
2	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
3	金融衍生品投资	—	—

4	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
5	银行存款和结算备付金合计	3,458,396.19	7.98
6	其他各项资产	128,646.63	0.30
7	合计	43,317,962.55	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	586,678.73	1.38
B	采矿业	—	—
C	制造业	27,540,498.98	64.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,523,110.62	5.94
E	建筑业	3,428,194.12	8.07
F	批发和零售业	2,147,513.35	5.06
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,144,933.27	5.05
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	560,149.83	1.32
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	559,292.91	1.32
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	240,547.92	0.57

S	综合	—	—
	合计	39,730,919.73	93.53

### 7.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	8,259	1,588,783.83	3.74
2	000651	格力电器	47,610	1,193,106.60	2.81
3	600887	伊利股份	32,172	1,006,340.16	2.37
4	601668	中国建筑	299,424	979,116.48	2.30
5	600104	上汽集团	66,568	879,363.28	2.07
6	000858	五粮液	37,794	757,391.76	1.78
7	600900	长江电力	98,413	681,017.96	1.60
8	000538	云南白药	6,833	574,040.33	1.35
9	600518	康美药业	29,772	572,515.56	1.35
10	000800	一汽轿车	44,003	541,236.90	1.27
11	601989	中国重工	117,582	531,470.64	1.25
12	600050	中国联通	168,274	525,014.88	1.24
13	000063	中兴通讯	39,671	505,805.25	1.19
14	000895	双汇发展	12,680	487,419.20	1.15
15	600535	天士力	12,154	475,829.10	1.12
16	000157	中联重科	87,326	474,180.18	1.12
17	600031	三一重工	60,967	457,862.17	1.08
18	600406	国电南瑞	30,216	451,124.88	1.06
19	002236	大华股份	11,780	450,349.40	1.06
20	600011	华能国际	83,867	447,849.78	1.05
21	002024	苏宁云商	88,167	441,716.67	1.04

22	000100	TCL 集团	194,005	440,391.35	1.04
23	600315	上海家化	9,344	420,386.56	0.99
24	002241	歌尔声学	11,406	413,923.74	0.97
25	000527	美的电器	32,721	406,394.82	0.96
26	000423	东阿阿胶	10,422	403,122.96	0.95
27	600795	国电电力	170,515	388,774.20	0.92
28	000069	华侨城 A	74,546	385,402.82	0.91
29	601117	中国化学	40,386	384,474.72	0.91
30	600893	航空动力	23,300	383,984.00	0.90
31	600089	特变电工	46,531	374,574.55	0.88
32	600690	青岛海尔	33,708	367,754.28	0.87
33	600309	万华化学	22,602	362,084.04	0.85
34	600276	恒瑞医药	13,735	362,054.60	0.85
35	002304	洋河股份	6,663	361,800.90	0.85
36	600066	宇通客车	18,395	337,180.35	0.79
37	000568	泸州老窖	14,066	334,489.48	0.79
38	002353	杰瑞股份	4,840	333,960.00	0.79
39	601299	中国北车	85,779	322,529.04	0.76
40	002038	双鹭药业	5,499	322,241.40	0.76
41	600739	辽宁成大	24,156	316,926.72	0.75
42	000338	潍柴动力	18,091	313,878.85	0.74
43	600637	百视通	11,184	313,152.00	0.74
44	002415	海康威视	8,413	297,315.42	0.70
45	601633	长城汽车	8,383	296,925.86	0.70
46	600085	同仁堂	12,881	281,836.28	0.66
47	600600	青岛啤酒	7,416	281,659.68	0.66
48	000999	华润三九	9,333	276,256.80	0.65
49	000581	威孚高科	8,266	276,001.74	0.65
50	600804	鹏博士	25,351	268,467.09	0.63
51	002081	金螳螂	9,370	266,763.90	0.63
52	601186	中国铁建	63,447	266,477.40	0.63

53	002422	科伦药业	4,959	264,364.29	0.62
54	000725	京东方 A	118,706	263,527.32	0.62
55	601766	中国南车	73,064	263,030.40	0.62
56	601390	中国中铁	101,445	247,525.80	0.58
57	600252	中恒集团	17,830	247,480.40	0.58
58	600196	复星医药	22,909	240,086.32	0.57
59	000768	中航飞机	25,910	230,599.00	0.54
60	600703	三安光电	11,661	229,022.04	0.54
61	000970	中科三环	17,556	228,930.24	0.54
62	600100	同方股份	32,581	223,505.66	0.53
63	601669	中国水电	76,502	220,325.76	0.52
64	000792	盐湖股份	12,915	218,780.10	0.52
65	600352	浙江龙盛	22,817	214,023.46	0.50
66	002570	贝因美	7,576	211,749.20	0.50
67	000623	吉林敖东	14,187	206,846.46	0.49
68	601607	上海医药	19,279	204,935.77	0.48
69	600886	国投电力	59,298	200,427.24	0.47
70	002594	比亚迪	6,696	200,277.36	0.47
71	600674	川投能源	19,347	196,758.99	0.46
72	000425	徐工机械	24,565	192,835.25	0.45
73	002310	东方园林	5,000	191,450.00	0.45
74	002385	大北农	17,823	183,933.36	0.43
75	600642	申能股份	47,059	178,824.20	0.42
76	600143	金发科技	36,706	177,289.98	0.42
77	600741	华域汽车	22,612	176,373.60	0.42
78	601717	郑煤机	28,030	175,187.50	0.41
79	600832	东方明珠	31,559	173,890.09	0.41
80	600694	大商股份	5,935	171,699.55	0.40
81	600153	建发股份	27,227	171,257.83	0.40
82	600108	亚盛集团	25,889	168,796.28	0.40
83	002202	金风科技	30,510	164,448.90	0.39

84	600068	葛洲坝	41,486	163,454.84	0.38
85	600150	中国船舶	10,085	163,074.45	0.38
86	000729	燕京啤酒	28,264	161,387.44	0.38
87	600177	雅戈尔	26,390	161,242.90	0.38
88	600655	豫园商城	24,525	159,657.75	0.38
89	600498	烽火通信	9,497	156,510.56	0.37
90	600718	东软集团	19,181	156,133.34	0.37
91	601618	中国中冶	96,874	155,967.14	0.37
92	600271	航天信息	11,708	154,779.76	0.36
93	601888	中国国旅	5,249	153,270.80	0.36
94	600415	小商品城	29,291	148,212.46	0.35
95	600062	XD华润双	7,367	147,487.34	0.35
96	600811	东方集团	29,618	146,016.74	0.34
97	600809	山西汾酒	5,896	144,452.00	0.34
98	002344	海宁皮城	7,470	142,751.70	0.34
99	002405	四维图新	10,077	140,876.46	0.33
100	600166	福田汽车	27,612	140,821.20	0.33
101	600598	北大荒	16,572	138,376.20	0.33
102	600267	海正药业	10,820	137,630.40	0.32
103	002375	亚厦股份	4,466	137,552.80	0.32
104	600875	东方电气	13,096	135,150.72	0.32
105	601928	凤凰传媒	15,942	134,072.22	0.32
106	002007	华兰生物	5,896	133,131.68	0.31
107	600839	四川长虹	73,776	132,059.04	0.31
108	002106	莱宝高科	8,503	130,521.05	0.31
109	600316	洪都航空	8,332	129,979.20	0.31
110	600664	哈药股份	20,895	124,116.30	0.29
111	000839	中信国安	18,190	117,325.50	0.28
112	000061	农产品	19,287	115,914.87	0.27
113	600827	友谊股份	16,712	114,811.44	0.27
114	601118	海南橡胶	27,445	113,622.30	0.27

115	600118	中国卫星	7,905	112,092.90	0.26
116	600027	华电国际	35,354	111,365.10	0.26
117	601179	中国西电	36,350	111,231.00	0.26
118	002092	中泰化学	21,227	107,833.16	0.25
119	600058	五矿发展	9,791	106,721.90	0.25
120	002073	软控股份	12,719	106,712.41	0.25
121	600372	中航电子	5,089	106,614.55	0.25
122	601098	中南传媒	11,449	106,475.70	0.25
123	600170	上海建工	15,519	106,149.96	0.25
124	601933	永辉超市	9,085	106,021.95	0.25
125	000876	新希望	10,731	105,700.35	0.25
126	002001	新和成	7,162	105,567.88	0.25
127	601106	中国一重	52,255	105,555.10	0.25
128	000422	湖北宜化	15,442	104,233.50	0.25
129	000528	柳工	15,571	101,211.50	0.24
130	600216	浙江医药	4,903	100,609.56	0.24
131	600770	综艺股份	16,836	99,332.40	0.23
132	601158	重庆水务	19,164	98,694.60	0.23
133	601800	中国交建	23,160	93,798.00	0.22
134	600863	内蒙华电	16,395	92,631.75	0.22
135	600160	巨化股份	15,880	92,580.40	0.22
136	600588	用友软件	10,027	89,641.38	0.21
137	600970	中材国际	9,620	88,504.00	0.21
138	600779	水井坊	7,713	88,390.98	0.21
139	002299	圣农发展	9,705	87,733.20	0.21
140	600132	重庆啤酒	5,807	87,279.21	0.21
141	600169	太原重工	36,471	84,977.43	0.20
142	600997	开滦股份	14,886	84,850.20	0.20
143	600528	中铁二局	17,460	84,506.40	0.20
144	000869	张裕A	2,452	83,711.28	0.20
145	600037	XD歌华有	13,729	83,197.74	0.20

146	600096	云天化	10,224	81,689.76	0.19
147	600859	王府井	5,061	81,532.71	0.19
148	002069	獐子岛	6,595	78,150.75	0.18
149	000559	万向钱潮	14,500	76,125.00	0.18
150	601558	华锐风电	19,200	73,152.00	0.17
151	601258	庞大集团	11,848	70,021.68	0.16
152	000703	恒逸石化	7,922	68,208.42	0.16
153	002431	棕榈园林	3,538	67,080.48	0.16
154	002399	海普瑞	3,647	64,916.60	0.15
155	000059	辽通化工	14,161	64,149.33	0.15
156	600582	天地科技	9,924	63,712.08	0.15
157	000961	中南建设	6,498	63,550.44	0.15
158	601216	内蒙君正	8,382	62,865.00	0.15
159	600873	梅花集团	14,606	57,985.82	0.14
160	600546	山煤国际	4,746	56,192.64	0.13
161	000596	古井贡酒	2,686	56,083.68	0.13
162	002603	以岭药业	2,257	51,369.32	0.12
163	002122	天马股份	13,882	49,558.74	0.12
164	601233	桐昆股份	6,578	33,284.68	0.08
165	601238	广汽集团	3,895	28,667.20	0.07
166	000883	湖北能源	5,680	27,434.40	0.06

### 7.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600104	上汽集团	1,180,693.13	0.91

2	000970	中科三环	838,471.00	0.65
3	002236	大华股份	760,394.87	0.59
4	600519	贵州茅台	582,804.00	0.45
5	600637	百视通	553,298.00	0.43
6	600886	国投电力	495,623.00	0.38
7	000651	格力电器	435,913.00	0.34
8	600027	华电国际	396,488.00	0.31
9	600011	华能国际	376,452.27	0.29
10	002375	亚厦股份	371,911.00	0.29
11	000858	五 粮 液	361,364.00	0.28
12	601800	中国交建	358,534.51	0.28
13	601668	中国建筑	344,828.00	0.27
14	600582	天地科技	323,492.75	0.25
15	002304	洋河股份	283,368.00	0.22
16	002594	比亚迪	251,658.00	0.19
17	002570	贝因美	249,868.32	0.19
18	000596	古井贡酒	222,000.00	0.17
19	600887	伊利股份	221,194.00	0.17
20	600031	三一重工	179,621.00	0.14

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	4,082,015.08	3.15
2	601668	中国建筑	2,643,873.17	2.04
3	000651	格力电器	2,615,683.38	2.02
4	000858	五 粮 液	2,339,749.41	1.81
5	600104	上汽集团	2,146,833.03	1.66
6	600887	伊利股份	2,005,053.87	1.55

7	000157	中联重科	1,754,531.83	1.35
8	600900	长江电力	1,586,389.31	1.22
9	002304	洋河股份	1,480,538.07	1.14
10	600050	中国联通	1,433,863.61	1.11
11	002024	苏宁云商	1,426,233.59	1.10
12	600031	三一重工	1,345,409.99	1.04
13	600518	康美药业	1,276,955.18	0.99
14	000538	云南白药	1,202,083.15	0.93
15	600406	国电南瑞	1,127,184.22	0.87
16	600011	华能国际	1,099,724.96	0.85
17	000423	东阿阿胶	1,086,381.50	0.84
18	000338	潍柴动力	1,074,746.88	0.83
19	000800	一汽轿车	1,053,701.88	0.81
20	600739	辽宁成大	1,053,335.32	0.81

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	13,496,474.74
卖出股票的收入（成交）总额	96,953,648.73

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末进行股指期货交易。

### 7.10 投资组合报告附注

**7.10.1**报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

**7.10.2**报告期内，本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

### 7.10.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	100,126.95
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	27,738.12
4	应收利息	781.56
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	其他	—
8	合计	128,646.63

### 7.10.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.10.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.10.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.10.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

### 7.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，本报告中涉及比例计算的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有 份额	占总份 额比例	持有 份额	占总份 额比例
1,132	38,807.18	2,664,549.60	6.07%	41,265,175.30	93.93%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	668,180.60	1.52%

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2012年06月25日)基金份额总额	277,132,832.76
本报告期期初基金份额总额	128,002,700.63
本报告期基金总申购份额	2,425,479.13
减：本报告期基金总赎回份额	86,498,454.86
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	43,929,724.90

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

## 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

## 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

## 10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内没有改聘会计师事务所，目前事务所已提供审计服务的连续年限为两年。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况

报告期内无基金管理人、基金托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况。

## 10.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		债券交易		债券回购交易		权证交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占股票成交总额比例	成交金额	占债券成交总额比例	成交金额	占债券回购成交总额比例	成交金额	占权证成交总额比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
海通证券	1	24,081,092.98	21.80%		—		—		—	21,923.67	21.98%	
东兴证券	1	19,490,567.06	17.65%		—		—		—	17,744.53	17.79%	
招商证券	1	18,432,980.61	16.69%		—		—		—	16,464.05	16.51%	
兴业证券	1	16,821,304.81	15.23%		—		—		—	14,959.83	15.00%	
民生证券	1	14,311,905.10	12.96%		—		—		—	13,029.43	13.07%	

中信建投	1	9,968,901.60	9.03%		—		—	9,075.61	9.10%
中信证券	1	7,343,371.31	6.65%		—		—	6,530.44	6.55%

注：1、基金租用席位的选择标准是：

- (1) 资历雄厚，信誉良好，财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (2) 经营行为规范，在最近一年内无重大违规经营行为；
- (3) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (4) 公司具有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供具有相当质量的关于宏观经济面分析、行业发展趋势及证券市场走向、个股分析的研究报告以及丰富全面的信息服务；能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

选择程序是：根据对各券商提供的各项投资、研究服务情况的考评结果，符合席位券商标准的，由公司研究部提出席位券商的调整意见（调整名单及调整原因），并经公司批准。

2、在上述租用的券商交易单元中，本基金本期无新增的交易单元，无剔除的交易单元。

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	信息披露方式	披露日期
1	长安沪深300非周期行业指数证券投资基金2012年第4季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、 www.changanfunds.com	2013-01-19
2	长安沪深300非周期行业指数证券投资基金招募说明书2012年第一次更新	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、 www.changanfunds.com	2013-02-07
3	长安沪深300非周期行业指数证券投资基金招募说明书2012年第一次更新摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、 www.changanfunds.com	2013-02-07
4	长安沪深300非周期行业指数证券投资基金2012年年度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、 www.changanfunds.com	2013-03-27
5	长安沪深300非周期行业指数证券投资基金2012年年度报告摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、 www.changanfunds.com	2013-03-27
6	长安基金管理有限公司关于旗下基金在上海好买基金销售有限公司开通定期定额投资业务并参加	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、 www.changanfunds.com	2013-03-29

	费率优惠活动的公告		
7	长安沪深300非周期行业指数证券投资基金2013年第1季度报告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、证券日报、 www.changanfunds.com	2013-04-23
8	长安基金管理有限公司关于开通多交易账户业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、证券日报、 www.changanfunds.com	2013-05-17
9	长安基金管理有限公司关于增加诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司、上海利得基金销售有限公司为旗下基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、证券日报、 www.changanfunds.com	2013-06-21

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、长安沪深300非周期行业指数证券投资基金基金合同；
- 3、长安沪深300非周期行业指数证券投资基金托管协议；
- 4、长安沪深300非周期行业指数证券投资基金招募说明书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内披露的各项公告。

### 12.2 存放地点

上海市浦东新区芳甸路1088号紫竹国际大厦16层。

### 12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人、基金托管人的办公场所或基金管理人网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本管理人。

咨询电话：400-820-9688

公司网址：[www.changanfunds.com](http://www.changanfunds.com)。

长安基金管理有限公司

二〇一三年八月二十九日